

文件编码：111MA-ZD (40)



山东金麒麟股份有限公司
SHANDONG GOLD PHOENIX CO., LTD.

期货交易管理制度

第三届董事会第二十二次会议审议通过



期货交易管理制度

文件编码：111MA-ZD (40)

版本号：A

页 码：第 2 页，共 6 页

第一条 目的

为规范期货交易监管流程，防范交易风险，确保公司金融资产安全，特制定本制度。

第二条 期货交易内容

针对公司生产经营过程中需要的主要原材料，例如钢材，为了规避成本的大幅上涨，利用期货进行套期保值操作，通过锁定成本锁定公司利润。

在对市场行情做出合理判断的情况下，可以进行相应的投资操作，通过期货收益增加公司利润。

第三条 期货投资业务决策程序

公司应当按照《公司章程》及《上海证券交易所股票上市规则》的相关规定履行董事会、股东大会的审议决策程序，并及时履行信息披露义务。

公司进行期货交易，如因交易频次和时效要求等原因难以对每次投资交易履行审议程序和披露义务的，可对上述事项的投资范围、投资额度及期限等进行合理预计，以额度金额为标准适用审议程序和信息披露义务的相关规定。相关额度的使用期限不应超过 12 个月，期限内任一时点的期货交易金额（含前述投资的收益进行再投资的相关金额）不应超过投资额度。

第四条 内部控制机制

（一）与期货公司订立的开户合同应按公司签订合同的有关规定及程序审核，并由公司董事长或董事长书面授权的人员签署。

（二）保证期货交易过程合法性及合规性，防范法律风险。

（三）严格公司内部控制，防范交易运作风险，有效控制投资风险。

（四）期货交易的品种必须为公司生产经营所需的原材料直接相关的品种。

第五条 组织机构和职责

（一）成立以公司领导层为主的公司期货交易管理小组，组长由公司董事长担任，成员由公司总裁、财务部、供应链管理部部长等负责人组成。管理小组按照《公司章程》等规定将期货交易事项提交董事会或股东大会审议，根据批准的交易计划，负责制定具体的交易方案及执行



期货交易管理制度

文件编码：111MA-ZD (40)

版本号：A

页 码：第 3 页，共 6 页

交易指令、价格预测、单据收集传递工作，定期汇报期货交易状况。

（二）成立风险控制小组，由公司财务部、审计部负责人组成，组长由审计部负责人担任。负责监督、稽核期货交易计划实施情况，不定期对期货交易事宜进行审计，对期货业务管理进行合规检查，对相关协议、文件等进行法律审核，防范因违反国家法律法规、政策和公司内部管理制度而产生的风险。

第六条 投资决策风险的控制

期货交易管理小组定期召开会议，研究宏观经济形势及市场状况，审核期货交易计划及方案，控制投资风险。必要时可以聘请专业机构就期货交易出具可行性分析报告。

第七条 投资交易风险的控制

一、期货交易基本原则

- （1）公司的期货交易应遵守国家法律、法规。
- （2）公司期货交易必须注重风险防范、保证资金运行安全。
- （3）公司应严格控制期货交易资金规模，不得影响公司正常经营。
- （4）公司不得使用募集资金从事期货交易。

二、内部控制制度

（1）与期货公司订立的开户合同应按公司签订合同的有关规定及程序审核，并由公司董事长或董事长书面授权的人员签署。

（2）交易授权制度。期货交易人员必须经过公司授权，授权应列明有权进行交易的人员名单、授权期限。被授权人只有在取得书面授权后方可进行授权范围内的操作。公司进行期货交易，必须执行严格的联合控制制度，即至少要由两名以上人员共同控制，且期货交易人员与资金、财务管理人员分离，相互制约。

（3）保密制度。公司期货期权业务相关人员应遵守公司的保密制度，期货期权业务相关人员未经允许不得泄露本公司的期货交易方案、交易情况、结算情况、资金状况等与公司期货交易有关的信息。期货业务人员发生变动的，期货交易管理小组应立即通知业务相关各方，期



期货交易管理制度

文件编码：111MA-ZD (40)

版本号：A

页 码：第 4 页，共 6 页

货业务相关人员自变动之日起，不再享有被授予的一切权利。人员变动后，期货交易管理小组应及时修改电话委托密码、网上交易密码、银期转账密码等机密信息，并及时与开户期货经纪公司联系，办理相应变更手续。

(4) 资料管理制度。公司对期货交易原始资料、结算资料等业务档案保存至少二十年。期货业务开户文件、授权文件等档案保存至少二十年。

三、期货交易流程

(1) 供应链管理部负责人定期根据市场行情等具体情况和市场价格，制定当月的期货交易计划书，财务部负责人根据资金情况协同编制，在董事会或股东大会的授权范围内报经期货交易管理小组组长批准后方可执行。

(2) 供应链管理部负责人根据批准后的交易计划书，结合实际情况制定具体的交易操作方案，经期货交易管理小组组长批准后执行。

(3) 供应链管理部负责人发起用款申请，经审批后，财务部负责人根据操作方案支付保证金。

(4) 供应链管理部负责人根据公司的交易操作方案选择合适的时机执行交易指令。每天交易结束后，供应链管理部负责人应及时将当日成交明细、结算情况向期货交易管理小组汇报。

(5) 财务部负责人根据供应链管理部负责人申请和期货帐户的盈亏情况，及时追加保证金。追加保证金之前需要向期货交易管理小组组长申请（超过董事会、股东大会授权额度的，需要报请董事会及股东大会审批），批准后方可追加。

(6) 每月的期货交易日结束后，供应链管理部负责人及时将期货业务的相关汇总数据交给董事会办公室，并向期货交易管理小组汇报交易总结。

(7) 公司根据实际情况，选择平仓或实物交割。如果需要进行实物交割了结期货头寸时，应提前对现货产品采购员、交易员及资金调拨员等相关各方进行妥善协调，以确保交割按期完成。

(8) 风险控制小组根据当月交易的资料、情况向期货交易管理小组出具当月交易评估报告。

(9) 交易信息通报制度。公司在发生人员变动或者相关资料发生变化后及时通知期货公司。



期货交易管理制度

文件编码：111MA-ZD (40)

版本号：A

页 码：第 5 页，共 6 页

四、风险管理

- (1) 风险管理与控制是首要任务，总风险必须控制在授权总额以内。
- (2) 设置止损上限，不允许超过公司最近一期经审计净资产的 10%。
- (3) 当境内期货价格波动较大或发生异常波动等情况时，期货操作人员应及时报告期货交易管理小组及董事会，期货交易管理小组及时召开小组会议并邀请有关人员参加，分析讨论风险情况及应采取的对策。
- (4) 相关期货操作人员必须执行公司的风险处理决定。
- (5) 合理安排资金，防止资金链断裂。
- (6) 风险控制小组相对独立运行，交易小组必须严格执行公司的期货交易风险控制制度。

第八条 流动性风险的控制

定期由财务部对期货资产流动性进行评估，监控期货资产流动性变动情况。

第九条 越权违规风险控制

各部门应根据公司经营计划、业务规则及自身具体情况制定本部门的作业流程、岗位职责和权限，同时分别在自己的授权范围内对关联部门及岗位进行监督并承担相应职责。

第十条 会计业务风险的控制

- (一) 遵循公认会计准则；
- (二) 实行会计复核与业务复核制；
- (三) 实行凭证管理制度，包括会计凭证登录、传递、归档等一系列管理制度；
- (四) 建立完善的数据录入、价格核对、价格确定；
- (五) 实行逐日对账制度。

第十一条 电脑系统风险的控制

- (一) 公司所有电脑设置密码及相应的权限；
- (二) 电脑系统机房空间隔离病设置门禁制度；
- (三) 建立操作安全管理制度；



期货交易管理制度

文件编码：111MA-ZD (40)

版本号：A

页 码：第 6 页，共 6 页

（四）建立计算机病毒防患制度

（五）建立数据备份制度；

（六）制定灾难恢复计划。

第十二条 人员流失风险的控制

（一）建立良好的企业文化和员工培训、成长以及激励机制，为优秀人才提供良好的成长环境；

（二）建立人才梯队队伍及人才储备机制，以保证重要岗位人员因各种原因离开公司时，后续人员能迅速补上。

第十三条 职业道德风险的控制

（一）加强对员工的守法意识、职业道德的教育，员工必须根据自身的工作岗位，提交自律承诺书，保证严格执行国家有关法律、法规和公司《员工手册》中的有关规定。员工的守法情况和职业道德将作为录用和提升的重要标准。

（二）根据不同的岗位和职责，制定相应的业务规则，明确各个岗位对保证公司规范运作的责任，规范各自的行为。

第十四条 金融市场危机等风险的控制

公司管理层加强调查研究，制定科学、合理的公司发展战略以有效防止金融市场危机和风险。

第十五条 合规风控的控制

期货交易管理小组应当依据法律法规以及行业自律规范的最新要求，不定期向董事长提供行业法规及行业自律规范方面的核查报告。涉及合规性制度更新的，应组织相关员工进行学习。

第十六条 本制度经董事会审议通过后施行，由董事会负责解释。